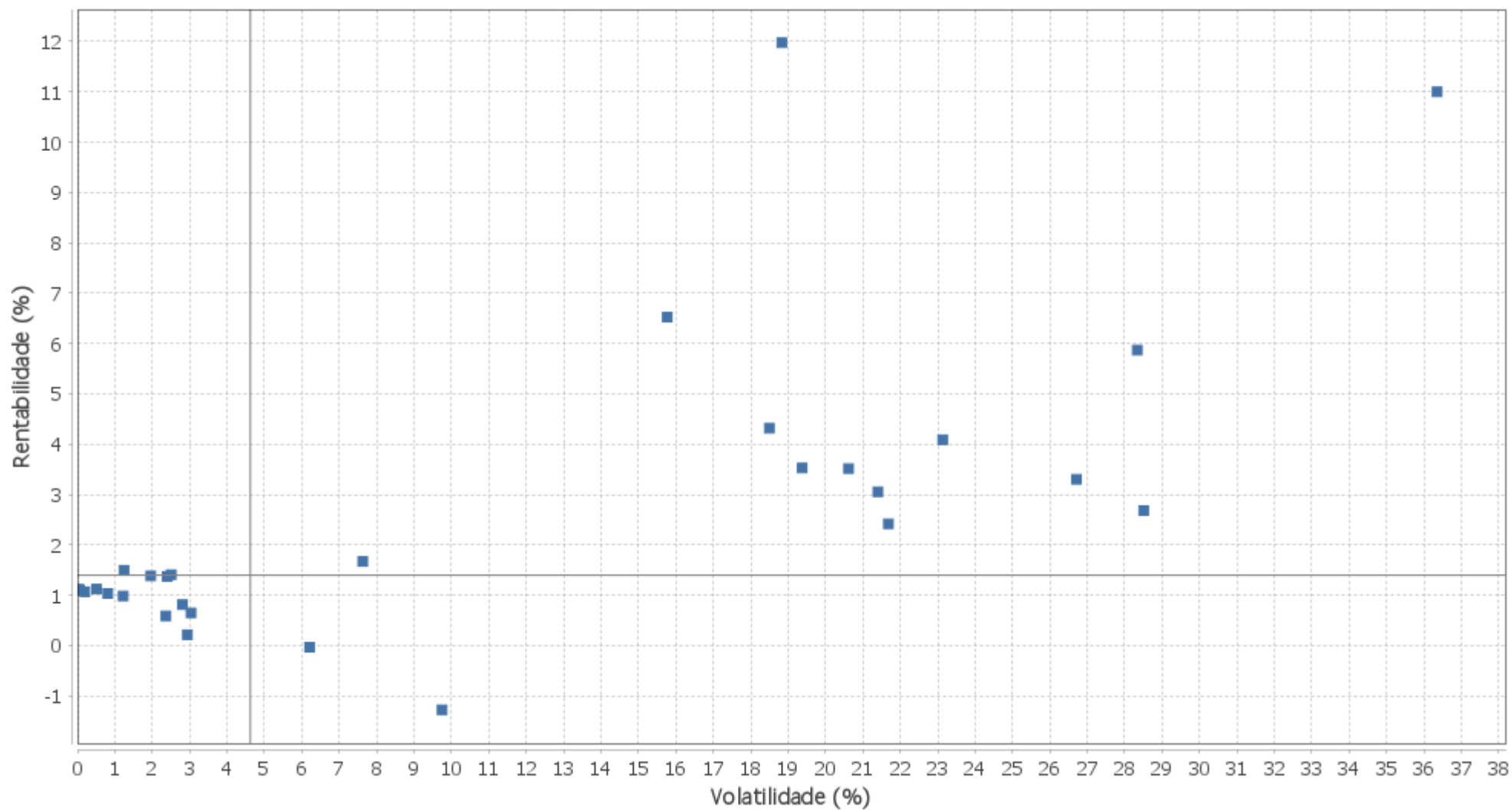


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 5.864.207,57

Value-At-Risk: 1,27%

|        | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|--------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| TOLEDO | 2,16                        | 1,27               | 1,27                | 0,19   | 1,53  | 462.776.380,54 | 100,00     |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,73%

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA    | 1,24                        | 0,81               | 0,01                | 0,80                | 0,30   | 1,50  | 14.373.224,07  | 3,11       |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI      | 3,04                        | 1,36               | 0,04                | 1,37                | -0,16  | 0,65  | 22.708.037,68  | 4,91       |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP              | 0,03                        | 0,02               | 0,00                | 0,02                | -0,20  | 1,12  | 27.462.985,96  | 5,93       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | 6,21                        | 2,95               | 0,14                | 0,03                | -0,19  | -0,03 | 32.514.624,69  | 7,03       |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         | 0,51                        | 0,15               | 0,00                | 0,02                | -0,00  | 1,12  | 26.285.415,64  | 5,68       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | 2,40                        | 1,39               | 0,06                | 0,02                | 0,10   | 1,37  | 32.142.751,01  | 6,95       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP     | 9,75                        | 4,39               | 0,02                | 0,05                | -0,25  | -1,28 | 3.437.697,75   | 0,74       |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,51                        | 1,56               | 0,05                | 0,37                | 0,11   | 1,41  | 23.773.155,92  | 5,14       |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        | 0,81                        | 0,62               | 0,04                | 0,65                | -0,11  | 1,04  | 53.447.391,05  | 11,55      |
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF          | 1,96                        | 1,36               | 0,02                | 2,08                | 0,13   | 1,38  | 9.655.816,14   | 2,09       |
| ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI             | 2,36                        | 0,67               | 0,01                | 0,67                | -0,23  | 0,59  | 37.388.069,38  | 8,08       |
| <b>Sub-total</b>                                    | 1,96                        | 0,96               | 0,39                |                     | -0,11  | 0,91  | 283.189.169,29 | 61,19      |

Artigo 7º III, Alínea a

| Ativo   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,04                        | 0,02               | -0,00               | 0,02                | -0,69  | 1,09  | 16.903.687,39 | 3,65       |
| FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI               | 0,06                        | 0,02               | 0,00                | 0,02                | -0,41  | 1,10  | 57.269.953,32 | 12,38      |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP               | 1,22                        | 0,83               | 0,01                | 0,84                | -0,11  | 0,98  | 8.993.649,35  | 1,94       |
| <b>Sub-total</b>                              | 0,12                        | 0,10               | 0,01                |                     | -0,31  | 1,09  | 83.167.290,06 | 17,97      |

Artigo 7º V, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA | 0,20                        | 0,05               | 0,00                | 0,05                | -0,28  | 1,07  | 12.672.046,42 | 2,74       |
| <b>Sub-total</b>                                      | 0,20                        | 0,05               | 0,00                |                     | -0,28  | 1,07  | 12.672.046,42 | 2,74       |

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,64%

Artigo 10º I

| Ativo  | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 2,81                        | 1,79               | 0,02                | 13,32               | -0,11  | 0,81  | 10.133.323,00 | 2,19       |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO              | 2,94                        | 2,00               | 0,01                | 10,95               | -0,31  | 0,21  | 7.220.250,38  | 1,56       |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP           | 15,77                       | 10,83              | 0,14                | 8,11                | 0,34   | 6,53  | 10.116.154,48 | 2,19       |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO                 | 7,63                        | 3,79               | 0,03                | 7,47                | 0,07   | 1,67  | 4.156.442,70  | 0,90       |
| <b>Sub-total</b>                                   | 5,45                        | 3,64               | 0,19                |                     | 0,26   | 2,55  | 31.626.170,56 | 6,83       |

Renda Variável

Value-At-Risk: 12,45%

Artigo 8º I

| Ativo  | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL                       | 28,33                       | 18,58              | 0,02                | 18,58               | 0,17   | 5,87  | 927.527,54    | 0,20       |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA                    | 21,40                       | 11,35              | 0,09                | 2,10                | 0,09   | 3,05  | 4.714.140,47  | 1,02       |
| FIA CAIXA CONSUMO                                | 28,51                       | 15,37              | 0,02                | 0,34                | 0,05   | 2,68  | 875.549,93    | 0,19       |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 19,38                       | 11,62              | 0,08                | 2,96                | 0,12   | 3,53  | 4.345.849,41  | 0,94       |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO                       | 26,71                       | 15,26              | 0,03                | 7,19                | 0,08   | 3,30  | 1.373.240,81  | 0,30       |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC                           | 21,68                       | 11,82              | 0,09                | 5,24                | 0,06   | 2,42  | 4.661.065,60  | 1,01       |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR                        | 20,62                       | 12,94              | 0,17                | 4,15                | 0,12   | 3,51  | 7.567.144,27  | 1,64       |
| ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI               | 23,13                       | 14,20              | 0,06                | 5,95                | 0,13   | 4,09  | 2.418.230,24  | 0,52       |
| <b>Sub-total</b>                                 | 20,93                       | 12,45              | 0,57                |                     | 0,11   | 3,34  | 26.882.748,27 | 5,81       |

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 11,82%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º II

| Ativo   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE            | 18,83                       | 12,71              | 0,11                | 9,37                | 0,58   | 11,98 | 7.876.854,85  | 1,70       |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 36,35                       | 19,50              | -0,02               | 19,49               | 0,27   | 11,00 | 3.202.259,85  | 0,69       |
| <b>Sub-total</b>  | 19,94                       | 12,80              | 0,09                |                     | 0,53   | 11,69 | 11.079.114,70 | 2,39       |

Artigo 9º III

| Ativo                               | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 18,50                       | 12,23              | 0,03                | 0,94                | 0,17   | 4,32  | 14.159.841,24 | 3,06       |
| <b>Sub-total</b>                    | 18,50                       | 12,23              | 0,03                |                     | 0,17   | 4,32  | 14.159.841,24 | 3,06       |